

《国债基差交易——为避险者、投机者和套利者提供的详解（第三版）》

书籍信息

版次：1

页数：

字数：

印刷时间：2010年12月01日

开本：12k

纸张：胶版纸

包装：平装

是否套装：否

国际标准书号ISBN：9787504957597

丛书名：金融期货与期权丛书

内容简介

《国债基差交易》一书自1989年首次出版发行以来，已经逐渐成为每个美国中长期国债期货专业交易员的指定参考用书。本书深入分析了美国中长期国债现货市场和期货市场之间的复杂关系，其所带来的套利机会及对市场的影响将有助于成千上万的避险者、投机者和套利者从中获利。

第三版对各类投资者来说必不可少，也反映了第二版出版以来的十多年间市场上出现的大量变化，主要包括：

- 更新对空头交割选择的估值方法的解释；
- 新加全球国债期货交易的内容以及组合经理的应用；
- 补充一些新图表、例子和个案来全面研究国债基差交易。

在美国开展长期国债期货交易三十多年来，长期国债基差的波动已经为避险者和交易者提供了可靠的交易机会。《国债基差交易》一书详细解释了相关投资机会的变动方式，并为职业交易者提供*的知识和技术来从中获利，也有助于在不断出现利率波动的情况下管理风险。

目录

第一章 基础概念

中长期国债期货的合约条款

国债基差的定义

报价单位

转换因子

转换因子的特征

期货发票价格

持有交易：持有国债的盈亏

理论国债基差

隐含回购利率

买卖基差

基差交易中利润的来源

另一种总盈亏计算方法

回购利率与逆回购利率

.....

第六章 基差交易

第八章 美国长期国债期货基差的九个阶段

第十章 组合管理者对国债期货的应用

[显示全部信息](#)

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

[更多资源请访问www.tushupdf.com](http://www.tushupdf.com)